

汇添富优势精选混合型证券投资基金 2023 年 中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§ 8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§ 9 开放式基金份额变动.....	57
§ 10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§ 12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富优势精选混合型证券投资基金
基金简称	汇添富优势精选混合
基金主代码	519008
前端交易代码	519008
后端交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 08 月 25 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,156,211,974.31
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于具有持续竞争优势的企业, 分享其在中国经济持续成长背景下的长期优异业绩, 为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采用适度动态资产配置策略, 同时运用汇添富持续竞争优势企业评估系统自下而上精选个股, 并对投资组合进行积极而有效的风险管理。主要投资策略为: 资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金是精选股票、并且进行积极风险控制的混合型基金, 本基金的风险和预期收益比较均衡, 在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-35,904,796.86
本期利润	-126,199,603.05
加权平均基金份额本期利润	-0.1106
本期加权平均净值利润率	-4.08%
本期基金份额净值增长率	-3.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,767,432,357.13
期末可供分配基金份额利润	1.5286
期末基金资产净值	2,923,644,331.44
期末基金份额净值	2.5286
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1426.25%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.07%	1.17%	0.95%	0.61%	1.12%	0.56%
过去三个月	-10.92%	1.05%	-3.18%	0.58%	-7.74%	0.47%
过去六个月	-3.82%	1.01%	0.20%	0.59%	-4.02%	0.42%
过去一年	-18.93%	1.07%	-9.04%	0.69%	-9.89%	0.38%
过去三年	-4.82%	1.46%	-1.34%	0.84%	-3.48%	0.62%
自基金合同生效日起至今	1426.25%	1.52%	269.87%	1.15%	1156.38%	0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富优势精选混合累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2005年08月25日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
王栩	本基金的基金经理, 总经理助理, 权益投资总监	2010 年 02 月 05 日		21	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任总经理助理、权益投资总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月 21 日至 2013 年 5 月 10 日任汇添富医

					<p>药保健混合型证券投资基金的基金经理。2012年7月10日至2015年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2013年6月25日至今任汇添富美丽30混合型证券投资基金的基金经理。2019年1月18日至2022年11月4日任汇添富外延增长主题股票型证券投资基金的基金经理。2020年1月8日至今任汇添富大盘核心资产增长混合型证券投资基金的基金经理。2021年9月7日至今任汇添富精选核心优势一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公

司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3日内、5日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成

交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 25 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场整体涨跌幅度不大，沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%，创业板指数下跌 5.61%。在指数整体平稳的表象下，市场实际波动比较剧烈，结构分化非常显著。市场大幅波动的一个重要原因是投资者经济复苏预期的变化。一季度开始，政府通过加大信贷供给等政策措施刺激经济，投资者对于经济在疫情之后的恢复总体抱有乐观预期，相关的周期性资产和消费类资产阶段性出现比较大幅度的上涨。但由于房地产行业快速下行，出口受外需影响也面临比较大的压力，随后的经济数据证伪了这种乐观预期。另外，人民币汇率上半年贬值幅度较大，也加剧了这类资产的下跌。在经济复苏偏弱的背景下，宽松的流动性是市场最大的支撑力量。投资者偏好两极分化：低风险偏好投资者青睐稳定性较强的低估值、高分红资产，尤其是中特估主题；高风险偏好投资者则聚焦于科技领域的投资主题，例如人工智能、机器人。海外方面，美联储如期放缓了加息的速度，上半年三次加息的幅度都为 25 个基点。但由于美国经济数据持续超出预期，预计年内降息的可能性不大，美国 10 年期国债利率大体维持在接近 4% 的较高水平。随着美联储加息进入尾声，全球风险资产价格普遍受益。上半年，美、欧、日、韩等发达国家的股票市场普遍大幅上涨，尤其是纳斯达克指数上涨超过 30%。商品价格方面，黄金、铜都录得上涨，而原油、铝、钢材等大宗商品价格则由于全球性的制造业不景气普遍处于弱势。上半年另外一件值得重视的重大事件是人工智能的突破性进展有可能引发新一轮科技革命。人工智能作为一项基础技术，其飞速进步不仅会推动信息技术产业快速发展，还可能对人类生活的各个方面都产生深远的影响。A 股市场上半年的表现基本上体现了上述宏观环境的变化和长期技术进步的可能性。分行业来看，上半年通信、传媒、计算机这三个行业受益于人工智能的加速发展而大幅上涨，其他如机械设备、家用电器、电子等行业的表现也相对较好，上涨幅度均超过 10%；而商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料、农林牧渔、食品饮料、基础化工等行业总体受经济复苏低于预期的影响而表现较差。

本基金年初的策略以经济复苏为主线，延续了去年在消费类和资源类资产上的持仓，另外增加了对家居产业链的投资。这一策略在一季度有所成效，但二季度遭受比较大的损失。三月份我们开始对上述策略做出修正，在坚持聚焦商业模式优秀的好公司的基础上，适当降

低了顺周期资产的配置，并加大了对通信、计算机行业的投资以顺应人工智能发展和国内数字化建设的中长期趋势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-3.82%。同期业绩比较基准收益率为 0.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为 A 股市场面临的外部环境趋于改善，市场整体向下风险不大，有相当大一部分资产已经处于比较底部的区间，投资的胜率在上升，理由如下。第一，尽管下半年经济复苏的强度仍有比较大的不确定性，但在政策再次强调发展的大背景下，有相当数量的行业正在走出底部，未来发展前景向好的可能性大幅上升。第二，随着美元加息周期的结束以及国内经济的逐步复苏，人民币汇率继续大幅贬值的风险不大。第三，A 股市场过去两年多显著落后全球股市，目前整体估值水平处于偏低的水平，甚至有部分行业的估值处于历史最低水平。第四，7 月份的政治局会议明确提出要活跃资本市场，提振投资者信心，市场风险偏好有望提升。下半年，我们一方面坚持自下而上精选个股、相对均衡配置的投资方法，另一方面也更加重视挖掘处于底部区间的产业链的投资机会，争取为持有人创造好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少一次，最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 80%。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富优势精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	252,311,293.12	186,277,052.31
结算备付金		2,915,155.49	3,609,053.59
存出保证金		479,361.96	560,918.45
交易性金融资产	6.4.7.2	2,670,861,344.11	2,721,942,652.90
其中：股票投资		2,670,861,344.11	2,721,942,652.90
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		2,535,089.06	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,005,483.31	1,199,496.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,930,107,727.05	2,913,589,173.67
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	5.48
应付赎回款		550,748.22	1,361,035.38
应付管理人报酬		3,594,677.86	3,752,762.18
应付托管费		599,112.95	625,460.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,718,856.58	1,733,953.17
负债合计		6,463,395.61	7,473,216.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,156,211,974.31	1,105,411,111.14
未分配利润	6.4.7.9	1,767,432,357.13	1,800,704,845.95
净资产合计		2,923,644,331.44	2,906,115,957.09
负债和净资产总计		2,930,107,727.05	2,913,589,173.67

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值2.5286元，基金份额总额1,156,211,974.31份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富优势精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-99,250,728.16	-243,464,961.63
1. 利息收入		431,591.33	752,614.28
其中：存款利息收入	6.4.7.10	431,591.33	752,614.28
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,562,668.86	-8,374,708.28
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-47,390,136.03	-23,782,655.35
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	621,866.79	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	37,205,600.38	15,407,947.07
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-90,294,806.19	-236,066,598.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	175,155.56	223,730.68
减：二、营业总支出		26,948,874.89	25,347,988.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,004,924.00	21,631,931.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,834,153.91	3,605,321.91
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		1.78	-
8. 其他费用	6.4.7.21	109,795.20	110,734.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-126,199,603.05	-268,812,950.11

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-126,199,603.05	-268,812,950.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-126,199,603.05	-268,812,950.11

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富优势精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,105,411,111.14	1,800,704,845.95	2,906,115,957.09
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,105,411,111.14	1,800,704,845.95	2,906,115,957.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,800,863.17	-33,272,488.82	17,528,374.35
（一）、综合收益总额	-	-126,199,603.05	-126,199,603.05
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	50,800,863.17	92,927,114.23	143,727,977.40
其中：1. 基金申购款	132,148,482.99	232,004,356.44	364,152,839.43
2. 基金赎回款	-81,347,619.82	-139,077,242.21	-220,424,862.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,156,211,974.31	1,767,432,357.13	2,923,644,331.44

项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	769,831,422.04	2,615,932,765.87	3,385,764,187.91
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	769,831,422.04	2,615,932,765.87	3,385,764,187.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	272,877,664.85	-406,477,292.95	-133,599,628.10
（一）、综合收益总额	-	-268,812,950.11	-268,812,950.11
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	272,877,664.85	569,193,274.85	842,070,939.70
其中：1. 基金申购款	350,460,041.42	722,626,113.12	1,073,086,154.54
2. 基金赎回款	-77,582,376.57	-153,432,838.27	-231,015,214.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-706,857,617.69	-706,857,617.69
四、本期期末净资产(基金净值)	1,042,709,086.89	2,209,455,472.92	3,252,164,559.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张暉	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富优势精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会

员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]105 号文《关于同意汇添富优势精选混合型证券投资基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开募集。基金合同于 2005 年 8 月 25 日生效。首次设立基金募集规模为 1,025,106,827.47 份基金份额，业经安永大华会计师事务所有限责任公司出具验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、存托凭证、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资对象主要是“持续竞争优势企业”。所谓持续竞争优势企业是指公司治理结构完善、管理层优秀，并在生产、技术、市场、政策环境等经营层面上具有一方面或多方面难以被竞争对手在短时间所模仿或超越的竞争优势的企业。具体来说，持续竞争优势企业具有以下五个基本特征：1、持续竞争优势企业具有良好的公司治理结构，信息透明，注重公众股东利益和投资者关系，历史上没有发生过由公司治理结构带来的风险事件；2、持续竞争优势企业具有优秀的管理层，且企业的经营实绩证明管理层是精明能干、正直诚实、富有理性的；3、持续竞争优势企业在生产、技术、市场、政策环境等经营层面上具有一方面或几方面竞争优势，而且，这种优势难以在短时间被竞争对手所模仿或超越；4、持续竞争优势企业的竞争优势与行业发展关键因素相契合，且其竞争优势能不断提升经营能力，强化其技术壁垒、市场占有率、品牌影响力等；5、持续竞争优势企业财务状况稳健，主营业务收入、净利润等主要财务指标具有良好增长性。在正常市场情况下，本基金投资于三类资产的比例范围为：股票及存托凭证 40-95%，债券 0-50%，权证 0-3%，现金类资产不低于 5%。持续竞争优势企业为股票及存托凭证主要投资对象，这类股票及存托凭证占股票及存托凭证资产净值的比例不低于 80%。今后在有关法律法规许可时，本基金资产配置比例可作相应调整，股票资产投资比例可达到法律法规有关规定的限额。本基金投资于具有持续竞争优势的企业，分享其在中国经济持续成长背景下的长期优异业绩，为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中

国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自 2008 年 10 月 9 日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2013 年 1 月 1 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2015 年 9 月 8 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	252,311,293.12
等于: 本金	252,289,299.44
加: 应计利息	21,993.68
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
合计	252,311,293.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,998,530,048.52	-	2,670,861,344.11	327,668,704.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,998,530,048.52	-	2,670,861,344.11	327,668,704.41

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	558.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,537,623.05
其中：交易所市场	1,537,623.05
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	121,167.52
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	1,718,856.58

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,105,411,111.14	1,105,411,111.14
本期申购	132,148,482.99	132,148,482.99
本期赎回（以“-”号填列）	-81,347,619.82	-81,347,619.82
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,156,211,974.31	1,156,211,974.31

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,111,600,606.07	-310,895,760.12	1,800,704,845.95
本期利润	-35,904,796.86	-90,294,806.19	-126,199,603.05
本期基金份额交易产生的变动数	95,929,459.78	-3,002,345.55	92,927,114.23
其中：基金申购款	249,218,571.77	-17,214,215.33	232,004,356.44
基金赎回款	-153,289,111.99	14,211,869.78	-139,077,242.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,171,625,268.99	-404,192,911.86	1,767,432,357.13

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	397,932.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,605.07
其他	5,053.70
合计	431,591.33

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	2,409,364,976.11
减：卖出股票成本总额	2,450,565,244.50
减：交易费用	6,189,867.64
买卖股票差价收入	-47,390,136.03

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	9,324.59
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	612,542.20
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	621,866.79

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,225,280.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,566,240.00
减：应计利息总额	46,371.62
减：交易费用	126.32
买卖债券差价收入	612,542.20

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

股票投资产生的股利收益	37,205,600.38
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	37,205,600.38

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-90,294,806.19
——股票投资	-90,294,806.19
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-90,294,806.19

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	175,155.56
替代损益	-
其他	-
合计	175,155.56

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

审计费用	40,167.52
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	523.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	597.31
合计	109,795.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	218,018,526.28	4.56	712,776,069.11	12.47

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	6,021,600.00	39.61	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	157,257.08	4.55	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)

东方证券	581,865.10	13.84	103,272.71	4.06
------	------------	-------	------------	------

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,004,924.00	21,631,931.60
其中：支付销售机构的客户维护费	6,502,809.54	6,384,626.20

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,834,153.91	3,605,321.91

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2005 年 08 月 25 日）持有的基金份 额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,096,307.62	-
报告期间申购/买入总份额	-	10,096,307.62
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总 份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,096,307.62	10,096,307.62
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例（%）	0.87	0.97

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名 称	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份 额	持有的基金 份额占基金 总份额的比	持有的基金份 额	持有的基金 份额占基金 总份额的比

		例 (%)		例 (%)
汇添富投资管理有限公司	18,116,594.80	1.57	18,116,594.80	1.64

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	252,311,293.12	397,932.56	216,998,543.70	716,053.82

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联	2023 年	6 个	新股	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	

	锻造	05 月 15 日	月	流 通 受 限						
001286	陕西能源	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
001287	中电港	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	
001328	登康口腔	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	
001360	南矿集团	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	
001367	海森药业	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
001380	华纬科技	2023 年 05 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	
301157	华塑科技	2023 年 03 月	6 个 月	新 股 流 通	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	

		01 日		受限						
301203	国泰环保	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新股 流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	
301260	格力博	2023 年 01 月 20 日	6 个 月	新股 流通 受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	
301281	科源制药	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新股 流通 受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个 月	新股 流通 受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	
301307	美利信	2023 年 04 月 14 日	6 个 月	新股 流通 受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	
301317	鑫磊股份	2023 年 01 月 12 日	6 个 月	新股 流通 受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	
301345	涛涛车业	2023 年 03 月 10 日	6 个 月	新股 流通 受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	

301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28
601065	江西省盐业集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00
601133	柏诚系统股份公司	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64
603125	江苏常青树	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80

	科技	日		限						
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
688146	中船派瑞特气	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	
688352	硕中科技	2023年04月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	

688535	华海诚科新材料	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“科源制药”（证券代码：301281）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的97股（根据山东科源制药股份有限公司2022年年度权益分派实施公告，科源制药以公司现有总股本77,350,000股为基数，向全体股东每10股派4元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增4股，除权除息日为2023年5月26日。）。本基金持有的流通受限股票“索辰科技”（证券代码：688507）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的72股（根据上海索辰信息科技股份有限公司2022年年度权益分派实施公告，索辰科技以公司现有总股本41,333,400股为基数，向全体股东每股派0.15元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每股转增0.48股，除权除息日为2023年6月20日。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开

放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023	1 个月以内	1-3 个月	3 个月	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-------------	--------	--------	------	-------	-------	-----	----

年 06 月 30 日		月	-1 年		上		
资产							
银行存款	252,311,293.12	-	-	-	-	-	252,311,293.12
结算备付金	2,915,155.49	-	-	-	-	-	2,915,155.49
存出保证金	479,361.96	-	-	-	-	-	479,361.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,670,861,344.11	2,670,861,344.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,535,089.06	2,535,089.06
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	90,976.31	-	-	-	-	914,507.00	1,005,483.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	255,796,786.88	-	-	-	-	2,674,310,940.17	2,930,107,727.05
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	550,748.22	550,748.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,594,677.86	3,594,677.86
应付托管费	-	-	-	-	-	599,112.95	599,112.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,718,856.58	1,718,856.58
负债	-	-	-	-	-	6,463,395.61	6,463,395.61

总计							
利率敏感 度缺口	255,796,786.88	-	-	-	-	2,667,847,544.56	2,923,644,331.44
上年 度末 2022 年12 月31 日	1个月以内	1- 3 个月	3 个 月 -1 年	1- 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资产							
银行 存款	186,277,052.31	-	-	-	-	-	186,277,052.31
结算 备付 金	3,609,053.59	-	-	-	-	-	3,609,053.59
存出 保证 金	560,918.45	-	-	-	-	-	560,918.45
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	2,721,942,652.90	2,721,942,652.90
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	102,628.49	-	-	-	-	1,096,867.93	1,199,496.42
递延 所得 税资	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	190,549,652.84	-	-	-	-	2,723,039,520.83	2,913,589,173.67
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	5.48	5.48
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,361,035.38	1,361,035.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,752,762.18	3,752,762.18
应付托管费	-	-	-	-	-	625,460.37	625,460.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

利润							
递延 所得 税负 债		-	-	-	-	-	-
其他 负债		-	-	-	-	1,733,953.17	1,733,953.17
负债 总计		-	-	-	-	7,473,216.58	7,473,216.58
利率 敏感 度缺 口	190,549,652.84	-	-	-	-	2,715,566,304.25	2,906,115,957.09

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,670,861,344.11	91.35	2,721,942,652.90	93.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,670,861,344.11	91.35	2,721,942,652.90	93.66

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	133,565,574.68	136,967,091.04
	沪深 300 指数下跌 5%	-133,565,574.68	-136,967,091.04

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日
---------------	-------------------------

第一层次	2,670,266,493.12
第二层次	32,023.04
第三层次	562,827.95
合计	2,670,861,344.11

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,670,861,344.11	91.15
	其中：股票	2,670,861,344.11	91.15
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	255,226,448.61	8.71
8	其他各项资产	4,019,934.33	0.14
9	合计	2,930,107,727.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	253,793,384.28	8.68
C	制造业	1,846,722,401.46	63.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	59,575.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	308,530,373.48	10.55
J	金融业	112,101,500.00	3.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	65,350,040.80	2.24
N	水利、环境和公共设施管理业	79,009.92	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	84,179,095.55	2.88
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,670,861,344.11	91.35

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	1,059,600	222,060,372.00	7.60
2	688111	金山办公	330,000	155,832,600.00	5.33
3	600702	舍得酒业	1,254,400	155,482,880.00	5.32
4	000063	中兴通讯	3,399,930	154,832,812.20	5.30
5	600188	兖矿能源	4,500,000	134,640,000.00	4.61
6	603198	迎驾贡酒	2,106,281	134,380,727.80	4.60
7	000651	格力电器	3,300,000	120,483,000.00	4.12
8	600256	广汇能源	17,369,298	119,153,384.28	4.08
9	688363	华熙生物	800,000	71,328,000.00	2.44
10	603882	金域医学	900,000	67,950,000.00	2.32
11	000860	顺鑫农业	1,950,000	65,695,500.00	2.25
12	600060	海信视像	2,603,300	64,431,675.00	2.20
13	600765	中航重机	2,300,000	60,973,000.00	2.09
14	000915	华特达因	1,600,000	56,464,000.00	1.93
15	002230	科大讯飞	819,903	55,720,607.88	1.91
16	600141	兴发集团	2,500,000	55,550,000.00	1.90
17	605089	味知香	1,380,000	54,234,000.00	1.86
18	002153	石基信息	3,769,859	52,778,026.00	1.81
19	600329	达仁堂	1,000,600	44,916,934.00	1.54
20	600872	中炬高新	1,200,000	44,148,000.00	1.51
21	601519	大智慧	6,000,000	42,960,000.00	1.47

22	688131	皓元医药	750,000	42,735,000.00	1.46
23	300803	指南针	850,000	41,301,500.00	1.41
24	003012	东鹏控股	4,599,901	37,213,199.09	1.27
25	603833	欧派家居	380,000	36,404,000.00	1.25
26	600488	津药药业	6,000,000	33,720,000.00	1.15
27	300848	美瑞新材	1,500,000	31,125,000.00	1.06
28	601318	中国平安	600,000	27,840,000.00	0.95
29	688383	新益昌科技	199,891	27,828,825.02	0.95
30	003006	百亚股份	1,600,000	27,648,000.00	0.95
31	688212	澳华内镜	400,000	27,160,000.00	0.93
32	688031	星环科技	200,142	26,666,920.08	0.91
33	300347	泰格医药	350,000	22,589,000.00	0.77
34	688690	纳微科技	550,000	21,367,500.00	0.73
35	688261	东微半导体	150,000	20,980,500.00	0.72
36	300911	亿田智能	550,000	20,883,500.00	0.71
37	600782	新钢股份	5,000,000	18,550,000.00	0.63
38	600446	金证股份	1,200,000	17,448,000.00	0.60
39	002043	兔宝宝	1,500,000	16,365,000.00	0.56
40	301267	华夏眼科	266,269	16,229,095.55	0.56
41	603180	金牌厨柜	450,097	15,087,251.44	0.52
42	688498	源杰科技	50,000	14,250,000.00	0.49
43	000893	亚钾国际	600,000	13,764,000.00	0.47

44	600398	海澜之家	2,000,000	13,760,000.00	0.47
45	688488	艾迪药业	1,100,000	13,552,000.00	0.46
46	688235	百济神州	120,000	13,093,200.00	0.45
47	603170	宝立食品科技	609,943	12,967,388.18	0.44
48	688378	奥来德光电	249,918	12,345,949.20	0.42
49	603351	威尔药业	450,000	12,069,000.00	0.41
50	603518	锦泓集团	1,000,000	11,350,000.00	0.39
51	603896	寿仙谷	200,000	8,860,000.00	0.30
52	002675	东诚药业	600,000	8,826,000.00	0.30
53	688630	芯碁微装	100,000	8,402,000.00	0.29
54	688122	西部超导	140,000	7,802,200.00	0.27
55	300286	安科瑞	200,000	7,572,000.00	0.26
56	600535	天士力	516,700	7,497,317.00	0.26
57	002242	九阳股份	500,000	7,475,000.00	0.26
58	002484	江海股份	300,000	6,387,000.00	0.22
59	002705	新宝股份	299,928	5,407,701.84	0.18
60	688062	迈威生物	250,000	5,382,500.00	0.18
61	300866	安克创新	50,000	4,375,000.00	0.15
62	688076	诺泰生物	100,000	3,558,000.00	0.12
63	600166	福田汽车	1,000,000	3,400,000.00	0.12
64	688177	百奥泰生物	100,000	2,671,000.00	0.09
65	002223	鱼跃医疗	50,000	1,799,500.00	0.06
66	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00

67	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
68	688480	赛恩斯环保	2,302	71,269.92	0.00
69	688146	中船派瑞特气	1,011	38,549.43	0.00
70	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
71	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
72	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.00
73	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
74	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
75	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
76	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.00
77	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
78	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
79	301327	华宝新能	315	24,919.65	0.00
80	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
81	301356	天振股份	1,105	24,199.50	0.00
82	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
83	301389	隆扬电子	1,269	23,070.42	0.00
84	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
85	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
86	301366	一博科技	482	20,942.90	0.00
87	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.00
88	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
89	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
90	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00

91	301396	宏景科技	475	15,508.75	0.00
92	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
93	301335	天元宠物	588	14,017.92	0.00
94	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
95	301349	信德新材	270	13,537.80	0.00
96	301235	华康医疗	418	13,300.76	0.00
97	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
98	301365	矩阵股份	774	12,740.04	0.00
99	301379	天山电子	449	12,540.57	0.00
100	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
101	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
102	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
103	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
104	601065	江西省盐业集团	875	10,360.00	0.00
105	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
106	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
107	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
108	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
109	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
110	301283	聚胶股份	235	8,337.80	0.00
111	688535	华海诚科新材料	161	8,248.03	0.00

112	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
113	601133	柏诚系统股份公司	664	8,140.64	0.00
114	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
115	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
116	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
117	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
118	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
119	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
120	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
121	603125	江苏常青树科技	160	3,924.80	0.00
122	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
123	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
124	300763	锦浪科技	30	3,123.00	0.00
125	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
126	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
127	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000063	中兴通讯	116,694,376.12	4.02
2	601360	三六零	77,958,052.40	2.68
3	000860	顺鑫农业	70,102,633.28	2.41

4	002153	石基信息	68,771,796.47	2.37
5	300033	同花顺	66,536,111.00	2.29
6	002230	科大讯飞	66,076,237.02	2.27
7	601519	大智慧	60,894,824.37	2.10
8	688111	金山办公	57,426,101.31	1.98
9	600256	广汇能源	56,472,919.17	1.94
10	600060	海信视像	56,004,301.71	1.93
11	605089	味知香	55,699,145.00	1.92
12	300229	拓尔思	54,546,722.33	1.88
13	600372	中航电子	53,900,000.00	1.85
14	601318	中国平安	52,475,927.00	1.81
15	300803	指南针	48,221,343.32	1.66
16	688235	百济神州	47,614,537.09	1.64
17	600329	达仁堂	46,165,679.00	1.59
18	600436	片仔癀	45,258,835.64	1.56
19	600446	金证股份	44,581,065.91	1.53
20	002463	沪电股份	40,429,621.00	1.39

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601360	三六零	115,318,244.60	3.97
2	300059	东方财富	93,531,254.09	3.22
3	000983	山西焦煤	80,996,789.07	2.79
4	000651	格力电器	75,794,246.17	2.61
5	002013	中航机电	74,755,771.14	2.57
6	300750	宁德时代	68,727,287.48	2.36
7	300033	同花顺	68,110,052.12	2.34
8	300598	诚迈科技	54,787,286.39	1.89
9	300229	拓尔思	54,026,648.38	1.86
10	600372	中航电子	52,966,607.03	1.82
11	688031	星环科技	47,493,664.19	1.63
12	603801	志邦家居	46,107,214.00	1.59
13	600641	万业企业	42,329,433.00	1.46
14	600436	片仔癀	41,643,244.20	1.43
15	002463	沪电股份	40,887,748.75	1.41
16	600315	上海家化	40,460,029.41	1.39
17	002594	比亚迪	40,109,779.88	1.38

18	002484	江海股份	38,101,068.06	1.31
19	002332	仙琚制药	36,979,971.52	1.27
20	600197	伊力特	36,357,015.64	1.25

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,489,778,741.90
卖出股票收入（成交）总额	2,409,364,976.11

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，广汇能源股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程

序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	479,361.96
2	应收清算款	2,535,089.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,005,483.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,019,934.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
153,820	7,516.66	34,049,544.71	2.94	1,122,162,429.60	97.06

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	304,533.89	0.03

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 08 月 25 日）基金份额总额	1,025,106,827.47
本报告期期初基金份额总额	1,105,411,111.14
本报告期基金总申购份额	132,148,482.99
减：本报告期基金总赎回份额	81,347,619.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,156,211,974.31

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券	1	866,879,623.07	18.12	625,270.56	18.10	
华泰证券	2	642,266,300.35	13.42	463,270.40	13.41	
长江证券	1	605,944,249.23	12.66	437,056.27	12.65	
国海证券	2	598,140,637.26	12.50	431,442.43	12.49	
平安证券	1	464,718,291.64	9.71	335,203.60	9.71	
瑞银证券	2	320,679,094.96	6.70	231,306.42	6.70	
东方证券	4	218,018,526.28	4.56	157,257.08	4.55	
海通	1	208,040,750.32	4.35	150,058.44	4.34	

证券						
中泰证券	1	176,479,063.90	3.69	127,295.01	3.69	
东吴证券	1	137,707,514.87	2.88	99,327.07	2.88	
国信证券	2	109,037,835.59	2.28	78,716.79	2.28	
兴业证券	1	93,737,822.25	1.96	67,612.21	1.96	
信达证券	1	80,987,048.78	1.69	58,415.86	1.69	
长城证券	2	65,770,780.06	1.37	47,442.24	1.37	
东兴证券	1	55,794,718.48	1.17	40,244.86	1.17	
申万宏源证券	1	55,702,274.00	1.16	40,177.90	1.16	
太平洋证券	2	43,955,024.94	0.92	31,704.89	0.92	
中银国际	1	21,425,720.52	0.45	15,454.52	0.45	
中金公司	2	12,026,783.00	0.25	11,200.33	0.32	
国泰君安	1	7,220,590.45	0.15	5,208.17	0.15	
东北证券	2	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信建投证券	3,157,810.55	20.77	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	6,021,600.00	39.61	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	6,021,240.00	39.61	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协

助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理人托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富优势精选混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富优势精选混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《汇添富优势精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富优势精选混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日